



گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی
برای سال مالی منتهی به ۳۰ بهمن ماه ۱۳۹۸

«ثبت شده به شماره ۱۱۴۴۶ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار»

اطلاعات مندرج در این گزارش که درباره عملیات و وضع عمومی صندوق می‌باشد، با تأکید بر ارائه منصفانه نتایج عملکرد گروه مدیران سرمایه‌گذاری و در جهت حفظ منابع صندوق و انطباق با مقررات قانونی و اساسنامه صندوق تهیه و ارائه گردیده است. این اطلاعات هماهنگ با واقعیت‌های موجود بوده و اثرات آن‌ها در آینده تا حدی که در موقعیت فعلی می‌توان پیش‌بینی نمود، به نحو درست و کافی در این گزارش ارائه گردیده و هیچ موضوعی که عدم آگاهی از آن موجب گمراهی استفاده‌کنندگان می‌شود، از گزارش حذف نگردیده و به تأیید مدیران سرمایه‌گذاری صندوق رسیده است.

معرفی «صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی»

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی که صندوقی در سرمایه‌گذاری اختصاصی و بازارگردانی موضوع بند (۲۰) ماده ۱ قانون بازار اوراق بهادار و بند هـ ماده ۱ قانون توسعه ابزارها و نهادهای مالی جدید محسوب می‌شود با اخذ مجوز تأسیس و فعالیت از سازمان بورس در تاریخ ۱۳/۰۵/۱۳۹۵ تحت شماره ۱۱۴۴۶ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار و شماره ۳۹۱۷۴ نزد مرجع ثبت شرکتها و موسسات غیر تجاری استان تهران به ثبت رسیده است. هدف از تشکیل این صندوق براساس اساسنامه و امیدنامه، جمع‌آوری سرمایه از سرمایه‌گذاران و خرید و فروش اوراق بهادار پذیرفته شده موضوع بند ۲-۲ امیدنامه (بانک دی، سرمایه‌گذاری بوعلی و بیمه دی) در چارچوب تعهدات بازارگردانی آن اوراق و کسب منافع از این محل است. همچنین چنانچه صرف و صلاح صندوق ایجاب کند، صندوق در قبال دریافت کارمزد در تعهد پذیرهنویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار موضوع بازارگردانی مشارکت کرده، که در این صورت وجوه جمع‌آوری شده و سایر دارایی‌های صندوق، پشتوانه این تعهد خواهد بود. عملکرد این صندوق براساس مفاد اساسنامه و امیدنامه در چارچوب قوانین و مقررات مربوطه است. فعالیت این صندوق تحت نظارت سبا انجام شده و متولی صندوق نیز به طور مستمر فعالیت آن را زیر نظر دارد. مدیریت دارایی‌های صندوق که عمدتاً شامل اوراق بهادار با درآمد ثابت و سهام شرکت‌های پذیرفته شده در بورس می‌باشد، توسط مدیران سرمایه‌گذاری صندوق صورت می‌گیرد. سرمایه‌گذاران در ازای سرمایه‌گذاری در این صندوق گواهی سرمایه‌گذاری دریافت می‌کنند. دوره فعالیت صندوق به مدت ۳ سال شمسی بوده (تا پایان ۱۴۰۱/۰۴/۲۸) که به تأیید سازمان بورس و اوراق بهادار رسیده است. مرکز اصلی صندوق در تهران- خیابان مطهری-کوچه منصور -پلاک ۶۶- طبقه اول واقع شده است. علاقمندان برای دریافت اطلاعات بیشتر در مورد الزامات فعالیت صندوق می‌توانند اساسنامه و امیدنامه صندوق را در تارنمای صندوق www.daygroupfund.net مطالعه کنند. برای دریافت اطلاعات مربوط به عملکرد گذشته صندوق نیز می‌توانید به تارنمای مزبور مراجعه کنید.

ارکان آن نیز مطابق جدول ذیل در مجمع عمومی مؤسس انتخاب شده و قبول سمت نمودند.

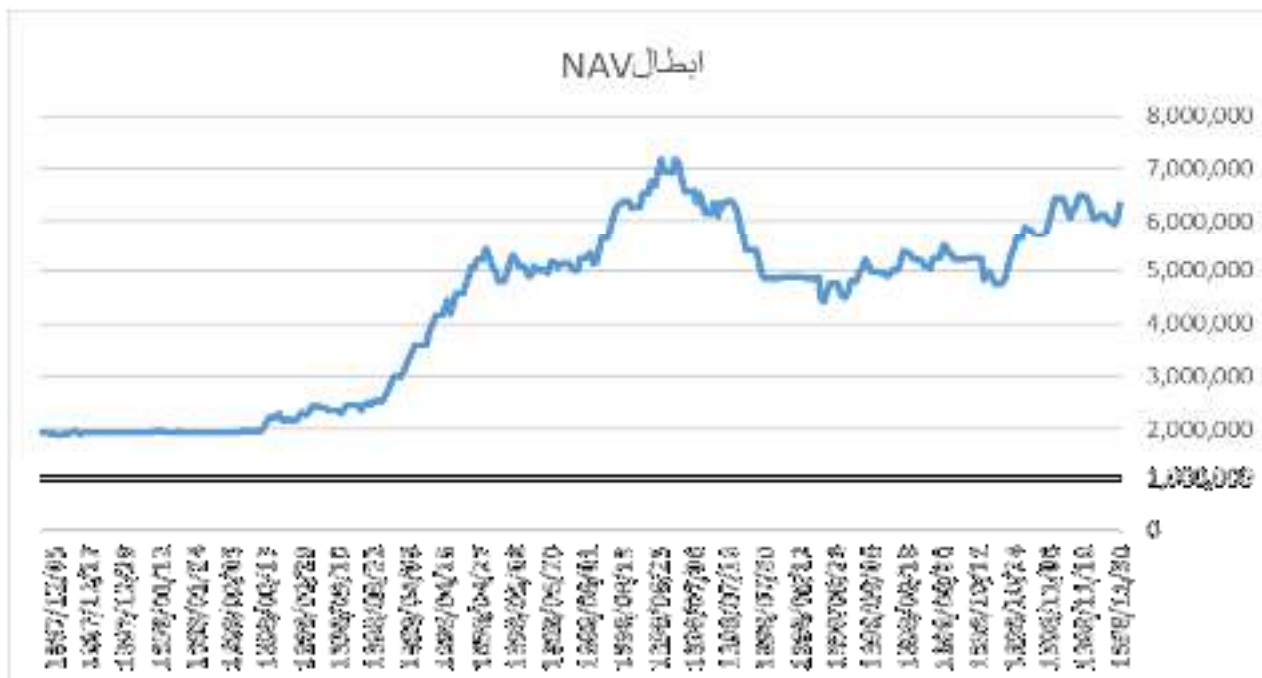
مدیر صندوق	کارگزاری بانک دی (سهامی خاص)
حسابرس	مؤسسه حسابرسی بهمند
متولی	مؤسسه حسابرسی آزمون پرداز ایران مشهود

عملیات اجرایی دوره

از تاریخ ۹۷/۱۲/۰۱ تا ۹۸/۱۱/۳۰ در ۳۶۵ روز فعالیت صندوق هیچ‌گونه درخواستی برای ابطال واحد در سیستم عملیاتی صندوق به ثبت نرسیده است. همچنین در تاریخ ۱۳۹۷/۱۲/۰۷ تعداد ۴۳.۷۳۶ واحد صدور انجام گرفته که در نتیجه آن تعداد واحدهای سرمایه گذاری صندوق در پایان دوره به ۴۱۸.۷۹۲ واحد رسیده است.

۳۷۲۰۵۶	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری در ابتدای دوره
۴۶.۷۳۶	تعداد واحدهای صادر شده
۰	تعداد واحدهای ابطالی
۴۱۸.۷۹۲	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری در انتهای دوره

قیمت ابطال صندوق از تاریخ ۱۳۹۷/۱۲/۰۱ تا ۱۳۹۸/۱۱/۳۰



منظور از صدور واحدهای سرمایه‌گذاری، ایجاد یک واحد سرمایه‌گذاری به نام سرمایه‌گذار و استفاده از وجوه آن برای انجام سرمایه‌گذاری جهت انجام فعالیت بازارگردانی سهام شرکت‌های موضوع بازارگردانی در صندوق است؛ منظور از ابطال واحد سرمایه‌گذاری، نقد کردن قسمتی از دارایی‌های صندوق و پرداخت وجوه حاصل از آن به سرمایه‌گذار و حذف یک واحد سرمایه‌گذاری از صندوق است.

خرید و فروش دارایی‌های صندوق

مطابق بند ۲-۲ امیدنامه، دارایی‌های صندوق تا تاریخ ۱۳۹۸/۱۱/۳۰ به صورت زیر نگهداری می‌شوند:

- سهام و حق تقدم سهام موضوع بند ۲-۲-۱ امیدنامه شامل بانک دی، سرمایه‌گذاری بوعلی و بیمه دی و تولید نیروی برق دماوند.
- موجودی نقد و گواهی سپرده.

- اوراق بهادار احراز شده بر اساس شرایط مندرج در بند ۲-۲ امیدنامه.

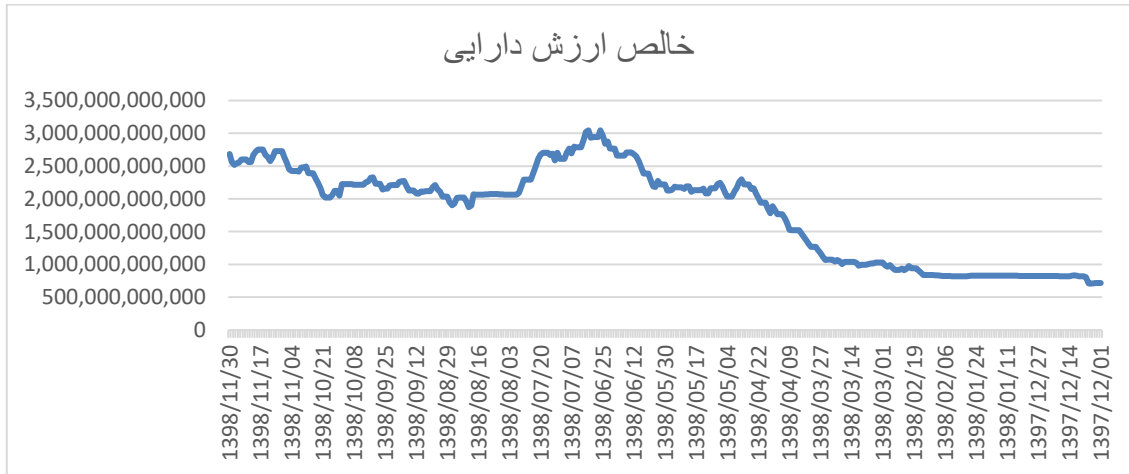
پایان دوره		اول دوره		شرح
ارزش	تعداد	ارزش	تعداد	
۲.۵۱۲.۵۷۶.۳۰۵.۷۲۴	۶۲۳.۷۷۷.۶۳۳	۶۷۷.۷۶۳.۰۷۳.۶۸۸	۵۷۱.۴۶۹.۷۰۸	بانک دی
۴۸.۵۶۰.۸۲۰.۱۸۶	۶.۵۲۸.۷۴۷	۱۱.۴۸۷.۹۳۷.۳۱۰	۹.۵۶۵.۳۱۰	بیمه دی
۹۷.۶۳۳.۷۵۰.۰۰۰	۱۸۵۰.۰۰۰	۲۱.۲۳۶.۷۴۶.۳۰۰	۹۴۹.۸۵۰	جماوند
۱۳.۰۰۲.۰۰۰.۰۰۰	۳.۰۰۰.۰۰۰	۴۵.۵۶۴.۲۹۲.۹۵۰	۲۷.۶۱۴.۷۲۳	سرمایه گذاری پوتلی
۲.۶۷۱.۷۷۲.۸۷۵.۹۱۰		۷۵۶.۰۵۲.۰۵۰.۲۴۸		مجموع

ترکیب سرمایه گذاران در پایان دوره (۱۳۹۸/۱۱/۳۰)

تمام واحدهای سرمایه گذاری صندوق در اختیار سرمایه گذاران حقوقی است.

شرح	تعداد	تعداد واحدهای سرمایه گذاری	درصد تملک صندوق
سرمایه گذاران حقیقی	۰	۰	۰
سرمایه گذاران حقوقی	۲	۴۱۸.۷۹۲	۱۰۰٪
کل سرمایه گذاران	۲	۴۱۸.۷۹۲	۱۰۰٪

نمودار خالص ارزش دارایی‌های صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی منتهی به تاریخ ۱۳۹۸/۱۱/۳۰



ارزش خالص کل دارایی صندوق سرمایه‌گذاری، نشان‌دهنده کل دارایی صندوق سرمایه‌گذاری پس از کسر هر گونه بدهی است. برای محاسبه این مقدار، ابتدا تمامی دارایی‌های یک صندوق محاسبه شده، سپس از این مقدار بدهی‌های کل صندوق کسر می‌گردد، عدد حاصله مقدار ارزش خالص کل دارایی صندوق سرمایه‌گذاری می‌باشد.

جدول ذیل نشان دهنده عملکرد صندوق طی دوره گذشته (تا تاریخ ۱۳۹۸/۱۱/۳۰) می‌باشد.

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازده صندوق (درصد)	بازده بازار (درصد)
۷ روز گذشته	۱۳۹۸/۱۱/۲۳	۱۳۹۸/۱۱/۳۰	%۳.۲۱۳	%۴.۲۸۶
یک ماه گذشته	۱۳۹۸/۱۰/۳۰	۱۳۹۸/۱۱/۳۰	%۸.۲۶۴	%۱۶.۸۲۴
سه ماه گذشته	۱۳۹۸/۰۸/۳۰	۱۳۹۸/۱۱/۳۰	%۳۱.۸۹۵	%۵۶.۹۷۱
۶ ماه گذشته	۱۳۹۸/۰۵/۳۰	۱۳۹۸/۱۱/۳۰	%۲۰.۸۰۲	%۷۹.۸۹۷
یک سال گذشته	۱۳۹۷/۱۱/۳۰	۱۳۹۸/۱۱/۳۰	%۲۱۳.۲۷۷	%۲۰۴.۱۸۹

صورت‌های مالی:

خلاصه صورت‌های مالی صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گروه دی برای دوره سالانه منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰ مطابق جداول ذیل می‌باشند:

صورت خالص دارایی ها سالانه منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰

۱۳۹۷/۱۱/۳۰	۱۳۹۸/۱۱/۳۰	یادداشت	دارایی ها:
ریال	ریال		
۷۵۳,۰۳۵,۴۰۲,۵۶۶	۲,۶۶۱,۱۱۲,۵۰۲,۱۳۴	۵	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۱,۶۰۲,۱۹۲,۷۶۸	۳۸,۴۴۹,۶۱۴,۸۱۸	۶	سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
-	۱,۴۶۵,۷۰۷,۲۹۵	۷	حسابهای دریافتی
-	۳,۹۸۸,۱۱۹,۱۰۶	۸	جاری کارگزاران
۱۷۲,۵۲۰,۹۱۶	۱۲۳,۹۵۲,۸۸۹	۹	سایر دارایی ها
۷۵۴,۸۱۰,۱۱۶,۲۵۰	۲,۷۰۵,۱۳۹,۸۹۶,۲۴۲		جمع دارایی ها
			بدهی ها:
۳۸۳,۴۷۷,۲۱۱	-	۸	جاری کارگزاران
۲,۹۳۴,۴۲۷,۵۵۹	۱۹,۴۹۰,۲۳۰,۵۲۱	۱۰	پرداختی به ارکان صندوق
۶۱۳,۴۵۸,۲۳۸	۲,۷۹۲,۸۷۷,۷۰۸	۱۱	سایر حسابهای پرداختی و ذخایر
۳,۹۳۱,۳۶۳,۰۰۸	۲۲,۲۸۳,۱۰۸,۲۲۹		جمع بدهی ها
۷۵۰,۸۷۸,۷۵۳,۲۴۲	۲,۶۸۲,۸۵۶,۷۸۸,۰۱۳	۱۲	خالص دارایی ها
۲,۰۱۸,۱۸۷	۶,۳۲۲,۵۱۲		خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری

یادداشتهای توضیحی همراه ، بخش جدایی ناپذیر صورتهای مالی می باشد.

صورت سود و زیان و گردش خالص داراییها شش ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰

سال مالی منتهی به ۱۳۹۷/۱۱/۳۰	سال مالی منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰	یادداشت	
ریال	ریال		درآمدها:
۱۰۲,۴۷۰,۰۴۳,۱۱۲	۴۹۶,۴۲۳,۱۴۳,۱۵۵	۱۳	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
۱۷۲,۲۲۴,۷۲۴,۴۸۷	۱,۳۴۹,۰۶۸,۷۶۸,۹۸۷	۱۴	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۵,۲۷۴,۱۱۸,۴۰۰	۸,۴۲۳,۳۵۵,۰۴۵	۱۵	سود سهام
۲۲,۶۱۱,۱۱۹,۷۴۷	۱۲,۲۵۸,۹۱۵,۰۸۱	۱۶	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۹۹۳,۰۸۰	-	۱۷	سایر درآمدها
<u>۳۰۲,۵۸۰,۹۹۸,۸۲۶</u>	<u>۱,۸۶۶,۱۷۴,۱۸۲,۲۶۸</u>		جمع درآمدها
			هزینه ها:
(۵,۰۰۹,۸۳۱,۸۸۶)	(۲۱,۷۷۶,۷۰۳,۵۳۸)	۱۸	هزینه کارمزد ارکان
(۸۳۲,۱۰۱,۰۵۶)	(۲,۴۱۷,۹۰۳,۰۸۹)	۱۹	سایر هزینه ها
<u>(۵,۸۴۱,۹۳۲,۹۴۲)</u>	<u>(۲۴,۱۹۴,۶۰۶,۶۲۷)</u>		جمع هزینه ها
<u>۲۹۶,۷۳۹,۰۶۵,۸۸۴</u>	<u>۱,۸۴۱,۹۷۹,۵۷۵,۶۴۱</u>		سودخالص
۴۹.۹۰٪	۶۸.۶۸٪		بازده سرمایه گذاری پایان سال (۱)
۶۵.۶۱٪	۱۰۱.۳۴٪		بازده میانگین سرمایه گذاری (۲)

صورت گردش خالص داراییها

سال مالی منتهی به ۱۳۹۷/۱۱/۳۰		سال مالی منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰		یادداشت	
ریال	تعداد	ریال	تعداد		
۵۴,۱۴۰,۱۹۷,۸۰۶	۵۰,۰۲۴	۷۵۰,۸۷۸,۷۵۳,۲۴۲	۳۷۲,۰۵۶		خالص داراییها (واحد سرمایه گذاری) اول سال
۳۲۲,۰۳۲,۰۰۰,۰۰۰	۳۲۲,۰۳۲	۵۳,۵۹۵,۰۰۰,۰۰۰	۵۳,۵۹۵		واحد های سرمایه گذاری صادر شده طی سال
-	-	(۱,۳۱۷,۰۰۰,۰۰۰)	(۱,۳۱۷)		واحد های سرمایه گذاری ابطال شده طی سال
۲۹۶,۷۳۹,۰۶۵,۸۸۴	-	۱,۸۴۱,۹۷۹,۵۷۵,۶۴۱	-		سود (زیان) خالص سال
۷۷,۹۶۷,۴۸۹,۵۵۲	-	۳۷,۷۲۰,۴۵۹,۰۰۸	-	۲۰	تعدیلات
<u>۷۵۰,۸۷۸,۷۵۳,۲۴۲</u>	<u>۳۷۲,۰۵۶</u>	<u>۲,۶۸۲,۸۵۶,۷۸۷,۸۹۱</u>	<u>۴۲۴,۳۳۴</u>		خالص داراییها (واحد سرمایه گذاری) پایان سال

یادداشت های توضیحی همراه، بخش جدایی ناپذیر صورتهای مالی می باشد.

$\frac{\text{تعدیلات ناشی از تفاوت قیمت صدور و ابطال} \pm \text{سود (زیان) خالص}}{\text{خالص داراییهای پایان سال}}$	=	بازده سرمایه گذاری پایان دوره (۱)
$\frac{\text{سود خالص}}{\text{میانگین موسزون (ریال) وجوه استفاده شده}}$	=	بازده میانگین سرمایه گذاری (۲)